

诺安保本混合型证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2012年8月29日
§1 重要提示
1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

§2 基金基本情况
2.1 基金基本情况
2.2 基金产品说明
2.3 基金管理人及基金托管人
2.4 信息披露方式

Table with 4 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日...

Table with 4 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日...

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标
金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日...

注:① 上述基金业绩指标不包括持有人申购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
② 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

§4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
截至2012年6月底,本基金经理人共管理二十一只开放式基金...

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日...

注:本基金的建仓期为2011年5月13日至2011年11月12日,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。截至2012年6月30日止,本基金建仓期结束未满1年。

§5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守信守情况
托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为...

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:诺安保本混合型证券投资基金
报告截止日:2012年6月30日

Table with 2 columns: 资产, 负债和所有者权益, 2012年6月30日, 2011年12月31日

6.2 利润表
会计主体:诺安保本混合型证券投资基金
报告截止日:2012年6月30日

Table with 2 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年5月13日至2011年6月30日, 上年度可比期间

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:诺安保本混合型证券投资基金
本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

Table with 2 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年5月13日至2011年6月30日, 上年度可比期间

6.4 管理人报告
6.4.1 基金管理人及其管理基金的情况
截至2012年6月底,本基金经理人共管理二十一只开放式基金...

注:① 此处在基金经理的任职日期为基金合同生效之日;
② 证券从业的合法含义从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

6.5 基金管理人报告
6.5.1 基金管理人及其管理基金的情况
截至2012年6月底,本基金经理人共管理二十一只开放式基金...

注:① 此处在基金经理的任职日期为基金合同生效之日;
② 证券从业的合法含义从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

6.6 基金管理人报告
6.6.1 基金管理人及其管理基金的情况
截至2012年6月底,本基金经理人共管理二十一只开放式基金...

注:① 此处在基金经理的任职日期为基金合同生效之日;
② 证券从业的合法含义从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

2012年6月30日

Table with 2 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年5月13日至2011年6月30日, 上年度可比期间

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:
基金管理人 薛有为
基金托管人 薛有为

6.4.1 重要会计政策和会计估计
6.4.2 差错更正的说明
6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
基金管理人于2012年2月25日发布公告,经诺安基金管理有限公司股东会决议通过,中国证券监督管理委员会批准,大恒新纪元科技股份有限公司受让北京中关村科学城建设股份有限公司持有的基金管理人20%的股权。

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系

注:下述关联方交易均在正常业务范围内,按一般商业条款订立。
6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.4.1.1 股票交易
6.4.4.1.2 权证交易

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金
6.4.4.2 关联方报酬
6.4.4.2.1 基金管理费

Table with 2 columns: 项目, 2012年1月1日至2012年6月30日, 2011年5月13日至2011年6月30日, 上年度可比期间

注:A. 基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.2 基金托管费
注:A. 基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.3 基金销售服务费
注:A. 基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.4 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.5 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.6 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.7 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.8 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.9 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.10 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.11 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.12 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.13 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.14 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.15 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.16 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.17 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.18 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.19 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.20 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.21 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.22 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.23 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.24 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.25 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.26 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.27 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.28 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.29 基金申购费
注:A. 基金申购费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金申购费
E为前一日基金资产净值

6.4.4.2.30 基金赎回费
注:A. 基金赎回费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.20%/当年天数
H为每日应计提的基金赎回费
E为前一日基金资产净值

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末未持有上述股票。
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:① 本期累计买入金额按买入成交金额,不考虑相关交易费用。
② 本基金本期仅买入上述股票。

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:① 本期累计买入金额按买入成交金额,不考虑相关交易费用。
② 本基金本期仅买入上述股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票投资明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:① 本期累计卖出金额按卖出成交金额,不考虑相关交易费用。
② 本基金本期仅卖出上述股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

7.9 投资组合报告期末持有的权证
7.9.1 本基金本报告期投资的前十名权证的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 5 columns: 持有户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者, 个人投资者, 占份额比例

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with 2 columns: 项目, 持有基金份额(份), 占基金份额比例

注:① 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门人员未持有该只基金。
② 本基金基金经理未持有该只基金。

§9 开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 基金合同生效日(2011年5月13日)基金份额总额, 基金份额变动

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的情况

Table with 5 columns: 券商名称, 交易单元数量, 成交金额, 占当期股票成交总额的比例, 佣金, 占当期股票佣金总额的比例

注:1. 本报告期租用证券公司交易单元的情况变更情况:无。
2. 专用交易单元的选择标准和程序
基金管理人选择使用专用交易单元的证券经营机构的选择标准为:

(1) 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。
(2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。
(3) 经营行为规范,最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
(4) 内部管理规范,严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。
(6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评审后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订《专用证券交易单元租用协议》。
10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

Table with 5 columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易

注:本基金租用的证券公司交易单元本期无权益交易。
投资者对本报告如有任何疑问,可致电本基金管理人全国统一客户服务热线:400-888-8998,亦可至基金管理人网站www.lionfund.com.cn查阅详情。

诺安基金管理有限公司
2012年8月29日